

工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货进行对冲的投资策略执行情况的公告

工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金（以下简称本基金）自 2014 年 6 月 26 日成立以来，在投资过程中严格执行《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）约定的投资政策并遵守中国金融期货交易所的各项监管要求：本基金根据量化模型确定权益类头寸的目标市场暴露度，调整权益类资产主动投资比例并利用股指期货空头合约进行套期保值。在股指期货套期保值过程中，本基金将定期测算权益类头寸与股指期货的相关性、投资组合 beta 的稳定性，精细化确定最优套保比例，以对冲股票市场风险。当出现大量净申购或净赎回的情况时，本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理，根据基金净申购或净赎回的规模，分别买入数量匹配的多头或者空头股指期货合约，并选择适当的时机平仓。

根据基金合同要求：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80% 120% 之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。

截至 2017 年 9 月 29 日，本基金持有股票资产市值共计 139,564,060.98 元，占基金资产净值比例为 57.56%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 111,951,420.00 元，占基金资产净值比例为 46.17%。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。

特此公告

工银瑞信基金管理有限公司

2017 年 10 月 19 日